

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
BIST TEMETTÜ ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 HESAP DÖNEMİNE AİT
PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN
PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK
DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT RAPORLARININ MEVZUATA
UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR

**ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
BIST TEMETTÜ ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ
TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT
RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**

Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Bist Temettü Endeksi Emeklilik Yatırım Fonu'nun ("Fon") Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Bist Temettü Endeksi Emeklilik Yatırım Fonu'nun Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu rapor tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka bir maksatla kullanılması mümkün değildir.

PwC Bağımsız Denetim ve
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.



Adnan Akan, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 15 Nisan 2020

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. BIST TEMETTÜ ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

					Faiz	Nominal		Birim						
Menkul		Satın Alış	Menkul	Faiz	Ödeme	Deger/		Alış	Değerleme	Birim	Günlük	Toplam	Toplam	Grup
Kıymet	Vade	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Kur	Fiyatı	Fiyatı	Deger	Kur		(%)	(%)
HİSSE SENETLERİ														
Hisse Türk														
ADANA		12/12/19	ADANA			15.724,00		6,73		9,71		152.680,04	0,26%	0,23%
ADEL		12/12/19	ADEL			2.153,00		15,31		15,70		33.802,10	0,06%	0,05%
ADNAC		12/12/19	ADNAC			13.603,00		2,29		2,23		30.334,69	0,05%	0,05%
AKBANK T.A.Ş.		12/12/19	AKBNK			855.896,02		6,64		8,11		6.941.316,69	11,78%	10,62%
AKCNS		12/12/19	AKCNS			11.103,00		10,46		10,04		111.474,12	0,19%	0,17%
AKMGY		12/12/19	AKMGY			2.129,00		22,94		23,68		50.414,72	0,09%	0,08%
AKSA		12/12/19	AKSA			23.821,00		11,755977		13,70		326.347,70	0,55%	0,50%
AKSGY		12/12/19	AKSGY			51.140,00		3,85		4,04		206.605,60	0,35%	0,32%
ALBARAKA TURK KATILIM BANKASI A.Ş.		12/12/19	ALBRK			88.685,00		1,29		1,53		135.688,05	0,23%	0,21%
ALCAR		12/12/19	ALCAR			488,00		50,7		60,00		29.280,00	0,05%	0,05%
ALGYO		12/12/19	ALGYO			1.592,00		96,088693		91,80		146.145,60	0,25%	0,22%
ALKIM		12/12/19	ALKIM			2.823,00		23,714665		38,32		108.177,36	0,18%	0,17%
ANHYT		12/12/19	ANHYT			21.674,41		6,729973		6,84		148.252,94	0,25%	0,23%
ARCLK		12/12/19	ARCLK			54.203,00		17,836897		20,84		1.129.590,52	1,92%	1,73%
ASELS		12/12/19	ASELS			91.975,91		22,265286		20,94		1.925.975,56	3,27%	2,95%
AVIVASA		12/12/19	AVISA			10.727,00		12,705971		13,94		149.534,38	0,25%	0,23%
AYGAZ		12/12/19	AYGAZ			22.318,00		14,529186		12,84		286.563,12	0,49%	0,44%
BFREN		12/12/19	BFREN			250,00		262,20		289,90		72.475,00	0,12%	0,11%
BIMAS		12/12/19	BIMAS			115.559,00		39,495945		46,66		5.391.982,94	9,15%	8,25%
BOLUC		12/12/19	BOLUC			10.424,00		3,809857		4,70		48.992,80	0,08%	0,07%
BR SAN		12/12/19	BR SAN			7.562,00		10,16		11,45		86.584,90	0,15%	0,13%
BUCIM		12/12/19	BUCIM			9.335,00		5,93		6,23		58.157,05	0,10%	0,09%
CEMTS		12/12/19	CEMTS			12.732,00		8,11		8,28		105.420,96	0,18%	0,16%
CIMSA		12/12/19	CIMSA			16.063,00		9,5		9,08		145.852,04	0,25%	0,22%
CLEBI		04/12/19	CLEBI			615,00		98,19878		102,10		62.791,50	0,11%	0,10%
DGATE		12/12/19	DGATE			3.125,00		7,864614		7,81		24.406,25	0,04%	0,04%
DO & CO AKTIENGESELLSCHAFT		12/12/19	DOCO			759,00		420,410632		564,00		428.076,00	0,73%	0,66%
ECILC		12/12/19	ECILC			40.502,00		3,58		3,71		150.262,42	0,25%	0,23%
ECZYT		12/12/19	ECZYT			7.160,00		10,07		10,11		72.387,60	0,12%	0,11%
EGEEN		04/12/19	EGEEN			379,00		477,623219		580,50		220.009,50	0,37%	0,34%
EGGUB		12/12/19	EGGUB			1.370,00		44,8		49,80		68.226,00	0,12%	0,10%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. BIST TEMETTÜ ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

					Faiz	Nominal		Birim						
Menkul		Satın Alış	İhraççı Kurum	Faiz	Ödeme	Deger/		Alış	Değerleme	Birim	Günlük	Toplam	Toplam	Grup
Kıymet	Vade	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Kur	Fiyatı	Fiyatı	Deger	Kur	Değer	(%)	(%)
ENKAI		12/12/19	ENKAI			186.006,29		4,899966		6,42		1194160,38	2,03%	1,83%
ERBOS		12/12/19	ERBOS			3.321,00		25,278591		24,98		82958,58	0,14%	0,13%
EREGL		12/12/19	EREGL			512.533,00		8,196975		9,04		4633298,32	7,86%	7,09%
FMIZP		12/12/19	FMIZP			627,00		30,689474		49,88		31274,76	0,05%	0,05%
FROTO		12/12/19	FROTO			20.077,00		58,35		70,85		1422455,45	2,41%	2,18%
T.GARANTİ BANKASI A.Ş.		12/12/19	GARAN			633.596,00		8,36		11,14		7058259,44	11,97%	10,78%
GENTS		12/12/19	GENTS			25.715,00		2		2,19		56315,85	0,10%	0,09%
GOODY		12/12/19	GOODY			19.307,00		2,504472		4,05		78193,35	0,13%	0,12%
İNDES		12/12/19	İNDES			8.977,00		10,062852		9,70		87076,9	0,15%	0,13%
T.İŞ BANKASI A.Ş.		12/12/19	ISCTR			442.578,00		5,716187		6,41		2836924,98	4,81%	4,34%
ISKENDERUN DEMİR ÇELİK		12/12/19	ISDMR			43.898,00		7,114848		8,01		351622,98	0,60%	0,54%
ISGYO		12/12/19	ISGYO			122.404,30		1,310202		1,76		215431,57	0,37%	0,33%
İŞ YATIRIM		12/12/19	ISMEN			31.534,00		4,021883		4,50		141903	0,24%	0,22%
JANTSA JANT SANAYİ VE TİC. A.Ş.		12/12/19	JANTS			421,00		56,25		58,30		24544,3	0,04%	0,04%
KCHOL		12/12/19	KCHOL			178.727,00		16,493535		20,32		3631732,64	6,16%	5,56%
KONYA		12/12/19	KONYA			250,00		261,824		271,30		67825	0,12%	0,10%
KORDS		12/12/19	KORDS			17.262,00		10,703284		13,08		225786,96	0,38%	0,35%
KUTPO		12/12/19	KUTPO			2.783,00		6,41		6,62		18423,46	0,03%	0,03%
		12/12/19	LKMNH			4.985,00		5,05		5,78		28813,3	0,05%	0,04%
MRDİN		12/12/19	MRDİN			14.563,00		5,66		5,92		86212,96	0,15%	0,13%
NUHCM		12/12/19	NUHCM			7.166,00		12,7		11,88		85132,08	0,14%	0,13%
ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN. VE TİC A.Ş.		15/11/19	ODAS			0,16		3,1875		2,10		0,34	0,00%	0,00%
PANORA GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.		12/12/19	PAGYO			8.762,00		5,85		6,20		54324,4	0,09%	0,08%
PETKM		04/12/19	PETKM			354.647,20		3,770998		3,81		1351205,83	2,29%	2,07%
PETÜN		12/12/19	PETÜN			4.529,00		8,96		9,17		41530,93	0,07%	0,06%
PNSUT		12/12/19	PNSUT			5.103,00		13,7		12,67		64655,01	0,11%	0,10%
AKTİFBANK		12/12/19	POLHO			37.529,00		2,81		3,03		113712,87	0,19%	0,17%
SAHOL		12/12/19	SAHOL			279.513,00		8,780748		9,54		2666554,02	4,52%	4,08%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş. BIST TEMETTÜ ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

Menkul					Faiz	Nominal		Birim						
		Satın Alış	İhraççı Kurum	Faiz	Ödeme	Deger/		Alış	O ORANI (%)	Birim	Günlük	Toplam	Toplam	Grup
Kıymet	Vade	Tarihi	Tanımı	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Kur	Fiyatı		Deger	Kur	Değer	(%)	(%)
SARKY		12/12/19	SARKY			38.884,00		4,6682		4,83		187.809,72	0,32%	0,29%
SELEC		12/12/19	SELEC			29.747,00		4,501076		6,10		181.456,70	0,31%	0,28%
SISE		12/12/19	SISE			242.803,66		5,080973		5,27		1.279.575,26	2,17%	1,96%
SODA		12/12/19	SODA			121.718,18		5,622539		6,18		752.218,36	1,28%	1,15%
TATGD		12/12/19	TATGD			18.048,00		5,97		6,29		113.521,92	0,19%	0,17%
TAVHL		12/12/19	TAV			45.984,00		24,61		29,18		1.341.813,12	2,28%	2,05%
TKFEN		12/12/19	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.			55.345,00		20,028018		19,32		1.069.265,40	1,81%	1,64%
TOASO		12/12/19	TOASO			37.491,00		18,80379		26,86		1.007.008,26	1,71%	1,54%
TRKCM		12/12/19	TRKCM			110.116,38		3,115645		3,50		385.407,32	0,65%	0,59%
TSKB		12/12/19	TSKB			348.553,78		1,204428		1,21		421.750,07	0,72%	0,64%
TTRAK		12/12/19	TTRAK			4.070,00		36,273113		55,40		225.478,00	0,38%	0,35%
TUPRS		12/12/19	TUPRS			38.177,00		131,716186		126,80		4.840.843,60	8,21%	7,41%
ULUSE		12/12/19	ULUSOY ELEKTRİK İMALAT TAAHHÜT VE TİCARET A.Ş.			1.516,00		25,310396		26,60		40.325,60	0,07%	0,06%
UNYEC		12/12/19	UNYEC			2.962,00		4,19		5,38		15.935,56	0,03%	0,02%
VAKBN		12/12/19	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.			196.048,00		4,274078		5,51		1.080.224,48	1,83%	1,65%
VERÜS		12/12/19	VERÜS			5.848,00		18,25		18,56		108.538,88	0,18%	0,17%
YGGYO		12/12/19	YGGYO			30.324,00		13,19		13,01		394.515,24	0,67%	0,60%
YKBNK		26/04/19	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			0,81		2,74		2,48		2,02	0,00%	0,00%
GRUP TOPLAMI										58.943.827,32			100,00%	90,20%
GRUP TOPLAMI										58.943.827,32			100,00%	90,20%
BORÇLANMA SENETLERİ													0,00%	0,00%
Devlet Tahvili													0,00%	0,00%
TRT170221T12		27/12/19	HAZİNE			892.000,00		103,4626		103,46		922.869,57	100,00%	1,41%
GRUP TOPLAMI										922.869,57			100,00%	1,41%
GRUP TOPLAMI										922.869,57			100,00%	1,41%
TPP													0,00%	0,00%
TPP		31/12/19				5.246.088,34		10,75		10,78		5.244.539,63	95,68%	8,03%
TPP		31/12/19				237.140,25		10,8		10,78		237.070,24	4,32%	0,36%
GRUP TOPLAMI												5.481.609,87	100,00%	8,39%
GRUP TOPLAMI												5.481.609,87	100,00%	8,39%

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
BIST TEMETTÜ ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

	31 Aralık 2019			31 Aralık 2018		
	Tutar	Grup	Toplam	Tutar	Grup	Toplam
	TL %	%		TL %	%	
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	65.348.307		100,06%	55.735.565	-	102,00
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ	65.348.307		0,03%	55.735.565	-	102,00
B,HAZIR DEĞERLER	22.487			12.493	100,00	0,2
a) Kasa	-	81,76%	0,03%	-	-	-
b) Bankalar	18.385	18,24%	0,01%	12.493	100,00	0,2
c) Diğer Hazır Değerler	4.101			-	-	-
C,ALACAKLAR	119.033		18,00%	1.955.832	100,00	0,04
a) Takastan Alacaklar T1	-			-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	-			1.862.240	9521%	0,03
c) Takastan BPP Alacakları	-			-	-	-
d) Kurucudan Alacaklar	-			-	-	-
e) Peşin Ödenen Giderler	-			-	-	-
h)Diğer Alacakalar	119.033	0,18%	es	93.592	479%	0,00
D,DİĞER VARLIKLAR	(182.392)			-	-	-
E,BORÇLAR			28,00%	(1.980.029)	(100,00)	(0,0)
a) Takasa Borçlar T1				(415.687)	%(2.099,00)	0,75
b) İhbarlı FonPay Takas	(75.661)		-	-	-	-
c) Yönetim Ücreti	(98.060)	5376,00%	15,00%	-	-	-
d)Hizmet Komisyonu				(92.377)	(4,7)	(0,2)
e) SPK Kayda Alma Ücreti	(1.959)	107,00%	1,00%	(1.672)	(0,1)	-
f)Ayrılan İhtiyatlar			-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	(6.712)	475,00%	1,00%	(5.576)	(0,3)	(0,0)
h)M.D Düşüş Karşılığı			-	-	-	-
ı) Pay Geri Alış Borçlar				(132.947)	-7%	-0,24
Fon toplam değeri	65.307.434		100,00	55.723.862		100,00